

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2021

Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.



Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2021)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	167.524.950,99	8,53%	1.007	1,70%	7º Ib
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREV...	D+1	Não há	110.822.420,07	5,64%	763	1,85%	7º Ib
19.303.795/0001-35	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	10.335.928,82	0,53%	140	1,81%	7º Ib
20.734.931/0001-20	BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	15/08/2024	21.529.470,98	1,10%	92	5,11%	7º Ib
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	316.664.070,63	16,12%	976	2,06%	7º Ib
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	126.322.561,01	6,43%	79	8,22%	7º Ib
13.455.117/0001-01	SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC ...	D+1	Não há	159.854.031,88	8,14%	180	11,44%	7º Ib
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FI...	D+3	Não há	136.497.867,50	6,95%	584	3,05%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	49.000.818,19	2,49%	737	1,05%	7º IV a
28.515.874/0001-09	BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC...	D+4	Não há	110.058.023,18	5,60%	195	8,14%	7º IV a
35.536.532/0001-22	CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA F...	D+1	Não há	24.334.326,80	1,24%	142	2,33%	7º IV a
00.834.074/0001-23	CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA C...	D+0	Não há	2.182,07	0,00%	16.078	0,00%	7º IV a
03.394.711/0001-86	BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+3	Não há	26.270.996,18	1,34%	53	7,75%	8º I a
13.058.816/0001-18	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF A...	D+4	Não há	83.868.615,02	4,27%	113	12,75%	8º I a
09.005.805/0001-00	BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	D+3	Não há	47.593.156,35	2,42%	58.072	2,52%	8º II a
07.882.792/0001-14	BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+3	Não há	26.587.781,21	1,35%	27.324	1,99%	8º II a
03.660.879/0001-96	BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+4	Não há	68.797.879,44	3,50%	178	9,75%	8º II a
30.068.224/0001-04	CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CICAÇ...	D+25	Não há	38.965.471,55	1,98%	2.319	3,71%	8º II a
30.068.169/0001-44	CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMIT...	D+15	Não há	25.823.212,51	1,31%	131	3,61%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	24.715.472,97	1,26%	478	0,77%	8º II a



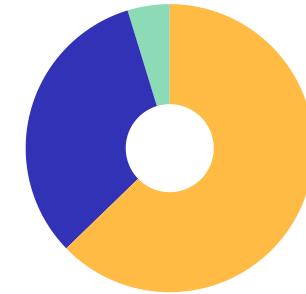
Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2021)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
24.571.992/0001-75	ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+24	Não há	57.973.346,42	2,95%	36.178	1,38%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	D+5	Não há	48.893.257,01	2,49%	55	4,40%	8º II a
32.665.845/0001-92	ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LI...	D+24	Não há	10.180.713,48	0,52%	18	2,77%	8º II a
32.666.326/0001-49	SAFRA AÇÕES LIVRE RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+33	Não há	1.355.084,59	0,07%	8.912	0,22%	8º II a
14.476.729/0001-43	SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB RESP LIMITADA FIF CIC ...	D+3	Não há	2.193.590,94	0,11%	442	0,66%	8º II a
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF M...	D+1	Não há	85.756.607,85	4,36%	18.650	2,79%	8º III
26.269.692/0001-61	ITAÚ S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+1	Não há	87.729.269,57	4,46%	1.279	3,53%	8º III
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.205.000,00	0,11%		1,56%	8º IV b
17.413.636/0001-68	BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	7.727.173,27	0,39%	100	0,34%	9º II
28.578.936/0001-13	BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	34.128.037,88	1,74%	87	2,90%	9º II
39.528.038/0001-77	CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	19.202.778,67	0,98%	1.189	9,82%	9º II
35.727.674/0001-77	ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+5 du	Não há	6.783.587,98	0,35%	200	0,42%	9º II
17.804.792/0001-50	SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	19.012.295,00	0,97%	13.112	0,96%	9º II
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDRAÇÕES RESP LIMITA...	D+5	Não há	6.139.432,76	0,31%	1.227	0,18%	9º III
Total para cálculo dos limites da Resolução				1.964.849.412,77				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS				10.245,29			Artigo 6º	
				PL Total	1.964.859.658,06			



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Agosto / 2021)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	30,00%	589.454.823,83
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	913.053.434,38	46,47%	12,00%	33,30%	90,00%	855.311.037,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	392.969.882,55
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	45,00%	319.893.217,74	16,28%	5,00%	23,00%	45,00%	564.289.018,01
Total Renda Fixa	100,00%	1.232.946.652,12	62,75%	17,00%	68,30%	185,00%	



- █ RENDA FIXA 1.232.946.652,12
- █ RENDA VARIÁVEL 638.909.455,09
- █ EXTERIOR 92.993.305,56

ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

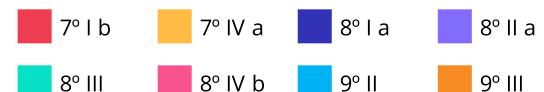
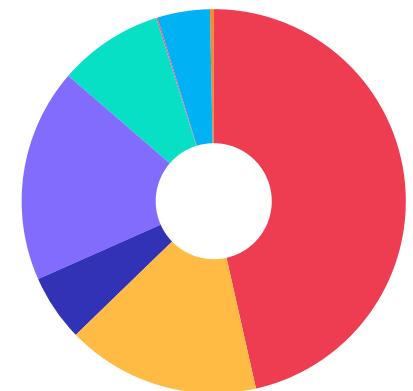




Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2021)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea a	35,00%	110.139.611,20	5,61%	1,00%	4,30%	35,00%	577.557.683,27
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	25,00%	353.078.966,47	17,97%	5,00%	16,00%	25,00%	138.133.386,72
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	173.485.877,42	8,83%	2,00%	7,90%	10,00%	22.999.063,86
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	2.205.000,00	0,11%	0,00%	0,30%	1,00%	17.443.494,13
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	638.909.455,09	32,52%	8,00%	28,50%	71,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	86.853.872,80	4,42%	0,00%	1,50%	10,00%	109.631.068,48
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.139.432,76	0,31%	0,00%	1,50%	10,00%	190.345.508,52
Total Exterior	10,00%	92.993.305,56	4,73%	0,00%	3,00%	20,00%	





Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	12,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	5,00	45,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea a	0,00	0,00	1,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	5,00	25,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	2,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00



Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM S.A	621.537.738,07	31,63	0,10
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	611.747.605,26	31,13	0,03
ITAU ASSET MANAGEMENT	278.808.764,98	14,19	0,02
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	178.866.326,88	9,10	0,04
BANCO BRADESCO	178.855.902,62	9,10	-
ITAU DTVM	59.073.970,49	3,01	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	26.270.996,18	1,34	0,00
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	9.688.108,29	0,49	-

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,26%	1,95%	-0,23%	2,29%	5,08%	15,28%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,18%	1,68%	0,17%	2,06%	5,08%	14,20%	1,09%	2,05%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,15%	1,47%	0,05%	1,97%	4,77%	14,45%	-	-
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,10%	1,30%	-0,06%	1,82%	4,51%	13,87%	1,31%	2,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,14%	1,32%	0,00%	1,86%	4,51%	13,99%	1,29%	2,35%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,13%	1,33%	-0,02%	1,85%	4,54%	13,99%	1,29%	2,34%
CDI (Benchmark)	0,43%	2,07%	1,10%	1,78%	2,72%	6,68%	-	-
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,24%	0,84%	0,58%	0,82%	0,89%	1,22%	0,01%	0,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	-0,46%	-0,96%	-0,52%	0,44%	1,76%	-	1,34%	3,48%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,45%	2,17%	1,17%	1,91%	2,78%	6,29%	0,03%	0,42%
IPCA (Benchmark)	0,87%	5,67%	2,38%	4,51%	9,68%	12,35%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	-1,40%	-1,30%	-1,90%	-0,87%	-0,34%	-	1,51%	2,30%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-0,50%	-1,50%	-0,37%	0,04%	0,46%	6,52%	1,57%	3,34%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-1,45%	-1,51%	-2,22%	-1,04%	-0,01%	9,20%	1,87%	2,61%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	1,75%	0,55%	2,36%	4,93%	14,07%	0,93%	2,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	2,29%	0,86%	2,60%	5,47%	13,77%	0,74%	1,97%



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2021 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,28%	19,22%	8,02%	8,11%	18,86%	99,63%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	2,44%	17,02%	6,70%	6,83%	16,19%	96,21%	6,20%	10,58%

Ibovespa (Benchmark)	-2,48%	-0,20%	-5,89%	7,95%	19,54%	17,45%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	-3,13%	-1,93%	-7,00%	4,44%	14,19%	15,31%	8,32%	19,83%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-4,79%	6,78%	-4,10%	9,31%	20,20%	31,75%	9,33%	18,24%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-2,78%	-0,21%	-5,92%	5,36%	12,20%	19,12%	8,49%	18,72%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-2,21%	6,37%	-5,41%	7,44%	21,25%	18,06%	7,73%	17,18%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-2,27%	-1,70%	-5,09%	4,18%	15,34%	3,86%	8,05%	15,69%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	-2,87%	4,86%	-7,43%	9,79%	19,41%	20,87%	8,64%	19,76%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-2,06%	0,75%	-5,54%	11,42%	22,72%	32,58%	7,26%	24,46%
SAFRA AÇÕES LIVRE RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-4,27%	5,31%	-3,72%	5,83%	18,03%	36,83%	8,90%	16,26%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-2,50%	-0,38%	-5,90%	7,77%	19,17%	16,93%	8,06%	22,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMITADA FIF CICAÇ...	-3,74%	-2,89%	-7,76%	1,95%	10,89%	20,06%	8,82%	17,76%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-2,51%	-0,42%	-5,98%	7,76%	19,18%	16,75%	8,14%	22,36%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-2,95%	10,96%	-8,28%	15,07%	29,81%	33,79%	9,85%	19,78%

IFIX (Benchmark)	-2,63%	-4,19%	-2,37%	-4,74%	-1,16%	3,51%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-1,01%	-46,29%	-19,76%	-25,00%	-52,58%	-33,00%	6,88%	35,37%



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2021 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	2,90%	20,41%	7,58%	18,67%	29,21%	54,54%	-	-
ITAU S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3,36%	23,12%	8,86%	20,09%	30,77%	54,73%	3,87%	13,56%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO LP	3,34%	23,18%	8,93%	20,01%	30,11%	52,19%	3,86%	13,66%

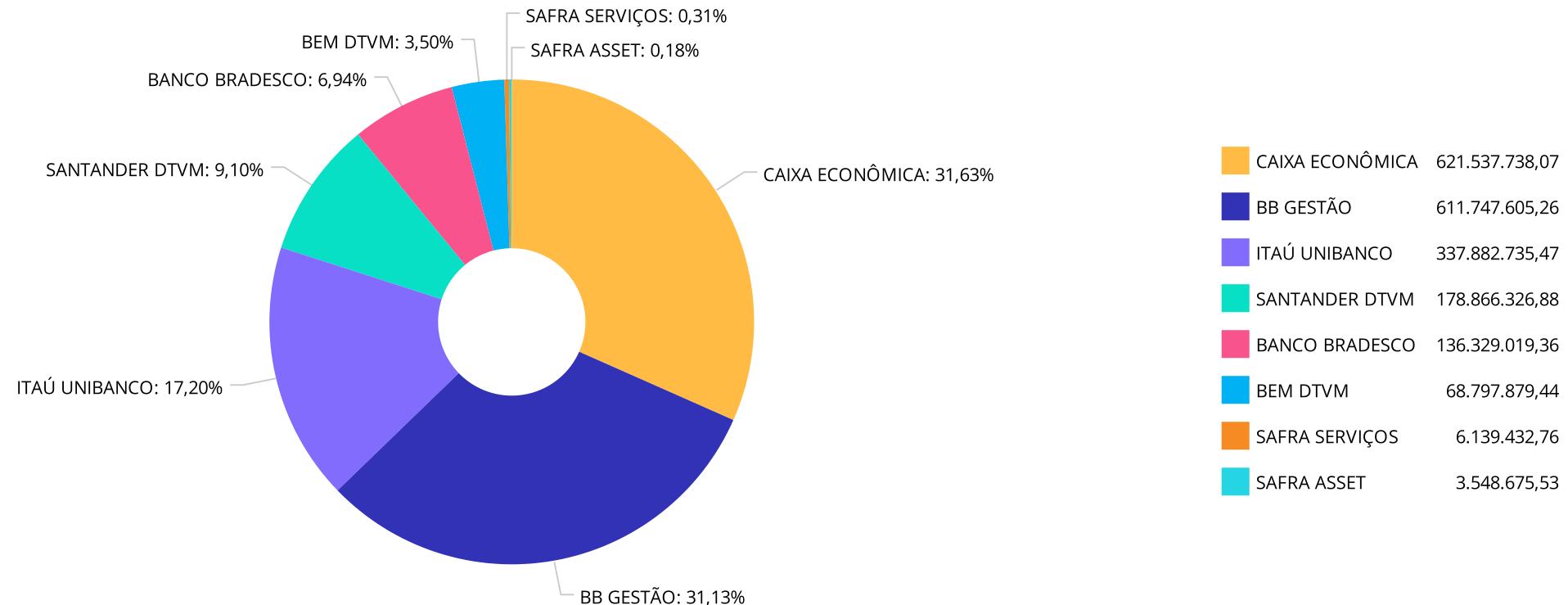


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

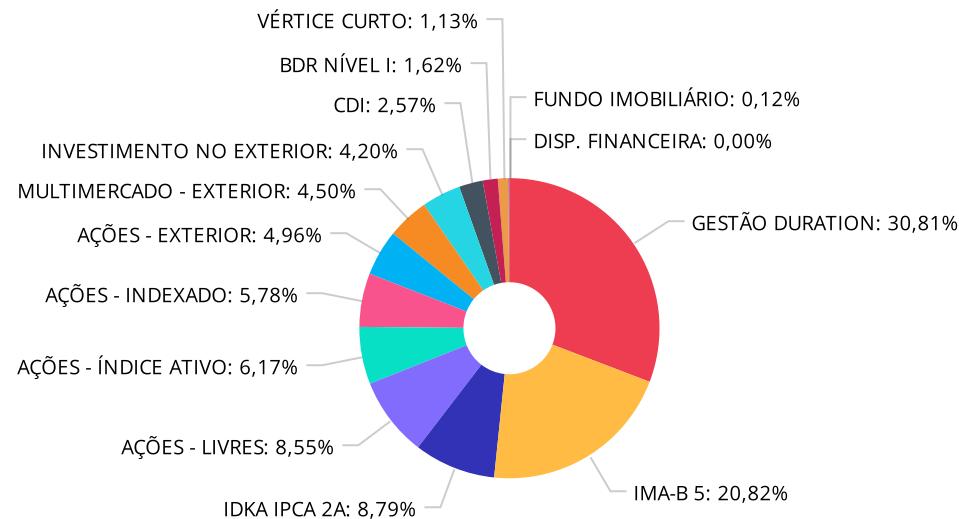
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,28%	19,22%	8,02%	8,11%	18,86%	99,63%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR AÇÕES RESP LIMITADA FIF AÇÕES	2,24%	20,01%	8,37%	10,72%	18,52%	82,12%	6,36%	10,151%

MSCI WORLD (Benchmark)	2,78%	15,58%	3,77%	7,14%	20,26%	82,56%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR R...	1,31%	14,44%	3,57%	3,57%	19,91%	97,55%	5,88%	10,453%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP LIMITADA F...	0,99%	2,74%	-4,01%	-8,09%	13,41%	-	6,00%	11,710%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP L...	0,81%	8,07%	5,11%	0,41%	-	-	5,27%	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	2,86%	19,28%	6,58%	8,85%	31,04%	116,23%	5,47%	12,291%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP LIMITADA FI...	0,91%	17,59%	2,75%	5,60%	25,24%	93,93%	5,92%	14,134%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Agosto / 2021)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Agosto / 2021)



■ GESTÃO DURATION	587.554.288,11	■ IMA-B 5	396.999.012,96	■ IDKA IPCA 2A	167.524.950,99	■ AÇÕES - LIVRES	163.079.200,70
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	117.691.136,45	■ AÇÕES - INDEXADO	110.139.611,20	■ AÇÕES - EXTERIOR	94.512.857,55	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	85.756.607,85
■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR	80.070.284,82	■ CDI	49.003.000,26	■ BDR NÍVEL I	30.854.905,73	■ VÉRTICE CURTO	21.529.470,98
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.205.000,00	■ DISP. FINANCEIRA	10.245,29				



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2021

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2021

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2021

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2021)

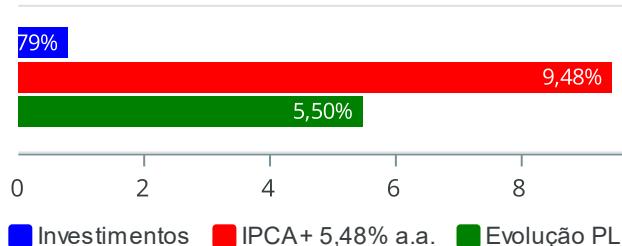
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	1.862.483.620,53	49.706.982,08	35.173.000,00	1.864.490.065,59	-12.527.537,02	-12.527.537,02	-0,67%	-0,67%	0,68%	0,68%	-98,82%	3,38%
Fevereiro	1.864.490.065,59	36.947.580,18	26.752.292,81	1.852.854.695,14	-21.830.657,82	-34.358.194,84	-1,16%	-1,82%	1,25%	1,93%	-94,57%	3,44%
Março	1.852.854.695,14	39.865.308,79	48.287.832,47	1.861.911.407,02	17.479.235,56	-16.878.959,28	0,92%	-0,92%	1,42%	3,38%	-27,15%	3,65%
Abril	1.861.911.407,02	62.415.274,17	34.014.544,28	1.913.007.018,22	22.694.881,31	5.815.922,03	1,20%	0,27%	0,74%	4,14%	6,57%	2,37%
Maio	1.913.007.018,22	120.318.723,83	109.062.779,77	1.954.165.549,26	29.902.586,98	35.718.509,01	1,55%	1,83%	1,28%	5,47%	33,45%	2,87%
Junho	1.954.165.549,26	61.459.292,38	51.620.045,66	1.966.502.408,55	2.497.612,57	38.216.121,58	0,13%	1,96%	0,98%	6,50%	30,14%	2,60%
Julho	1.966.502.408,55	193.947.735,09	183.525.184,67	1.962.850.600,30	-14.074.358,67	24.141.762,91	-0,71%	1,23%	1,43%	8,03%	15,37%	3,56%
Agosto	1.962.850.600,30	64.080.791,79	53.465.794,37	1.964.849.412,77	-8.616.184,95	15.525.577,96	-0,44%	0,79%	1,34%	9,48%	8,36%	3,40%

Investimentos x Meta de Rentabilidade x PL





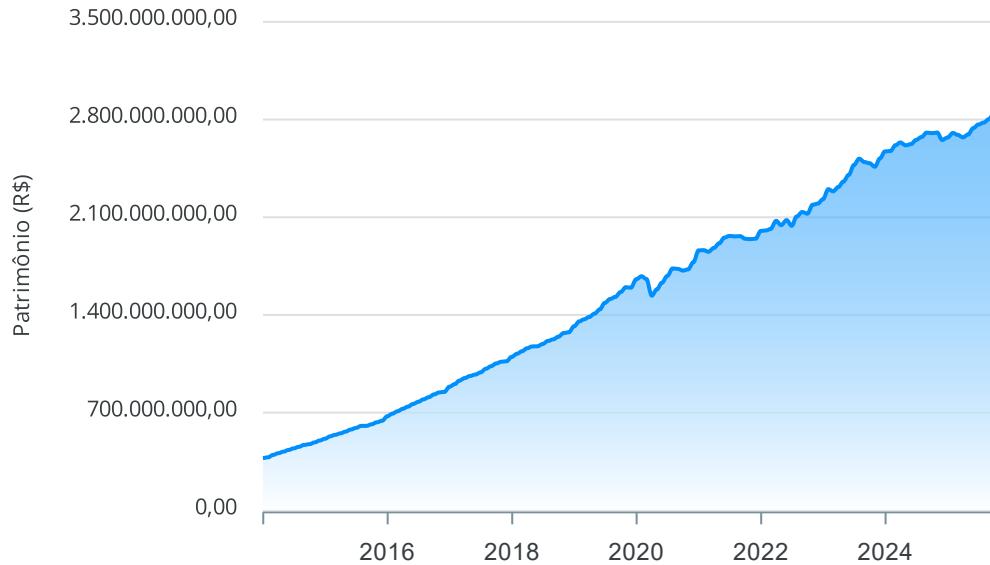
CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

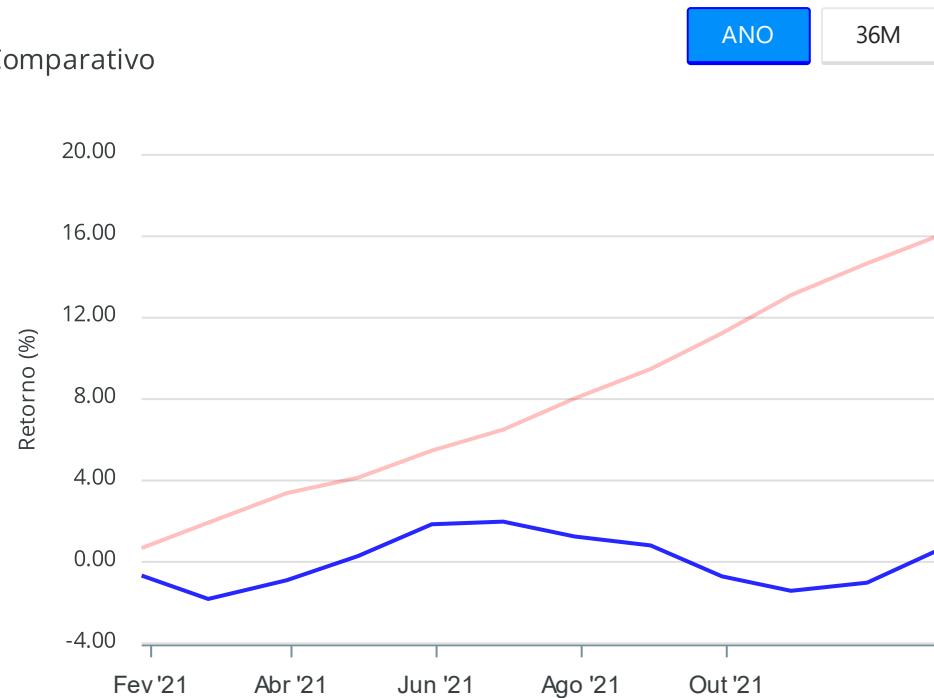
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2021

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMML IDIV



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.582.737,77	0,00	278.550,64	10.335.928,82	31.741,69	0,30%	0,31%	0,74%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	47.057.881,23	28.553.800,00	26.797.000,00	49.000.818,19	186.136,96	0,25%	0,45%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	22.049.722,31	0,00	569.560,93	21.529.470,98	49.309,60	0,22%	0,24%	0,93%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	167.226.505,65	0,00	0,00	167.524.950,99	298.445,34	0,18%	0,18%	1,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	126.151.217,10	0,00	0,00	126.322.561,01	171.343,91	0,14%	0,14%	1,29%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RE...	159.649.078,33	0,00	0,00	159.854.031,88	204.953,55	0,13%	0,13%	1,29%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVID...	110.707.732,51	0,00	0,00	110.822.420,07	114.687,56	0,10%	0,10%	1,31%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CUR...	2.171,72	32.430,81	32.430,81	2.182,07	10,35	0,03%	0,24%	0,01%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	0,00	1.406.309,01	1.406.516,65	0,00	207,64	0,01%	0,30%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	137.121.598,97	0,00	0,00	136.497.867,50	-623.731,47	-0,45%	-0,45%	1,34%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC R...	110.615.209,31	0,00	0,00	110.058.023,18	-557.186,13	-0,50%	-0,50%	1,57%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	24.680.440,12	0,00	0,00	24.334.326,80	-346.113,32	-1,40%	-1,40%	1,51%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	321.308.262,67	13.500,00	0,00	316.664.070,63	-4.657.692,04	-1,45%	-1,45%	1,87%
Total Renda Fixa	1.237.152.557,69	30.006.039,82	29.084.059,03	1.232.946.652,12	-5.127.886,36	-0,41%		1,39%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	84.879.866,24	0,00	0,00	87.729.269,57	2.849.403,33	3,36%	3,36%	3,87%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF MUL...	82.985.852,58	0,00	0,00	85.756.607,85	2.770.755,27	3,34%	3,34%	3,86%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR RESP LIMITADA...	24.326.518,81	0,00	24.368.235,34	0,00	41.716,53	0,17%	-2,10%	8,57%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.227.500,00	0,00	13.500,00	2.205.000,00	-9.000,00	-0,40%	-1,01%	6,88%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	14.834.347,25	12.184.117,66	0,00	26.587.781,21	-430.683,70	-1,59%	-2,06%	7,26%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITAD...	14.175.083,84	12.184.117,66	0,00	25.823.212,51	-535.988,99	-2,03%	-2,95%	9,85%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	59.280.610,02	0,00	0,00	57.973.346,42	-1.307.263,60	-2,21%	-2,21%	7,73%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	70.393.998,02	0,00	0,00	68.797.879,44	-1.596.118,58	-2,27%	-2,27%	8,05%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕ...	86.018.621,60	0,00	0,00	83.868.615,02	-2.150.006,58	-2,50%	-2,50%	8,06%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	26.946.238,35	0,00	0,00	26.270.996,18	-675.242,17	-2,51%	-2,51%	8,14%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕE...	40.080.536,61	0,00	0,00	38.965.471,55	-1.115.065,06	-2,78%	-1,74%	8,49%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	48.999.893,66	0,00	0,00	47.593.156,35	-1.406.737,31	-2,87%	-2,87%	8,64%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	50.474.526,58	0,00	0,00	48.893.257,01	-1.581.269,57	-3,13%	-3,13%	8,32%
SAFRA AÇÕES LIVRE RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,00	1.406.516,65	0,00	1.355.084,59	-51.432,06	-3,66%	-4,27%	8,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMI...	10.576.530,97	0,00	0,00	10.180.713,48	-395.817,49	-3,74%	-3,74%	8,82%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB RESP LIMITADA FIF CIC AÇ...	0,00	2.300.000,00	0,00	2.193.590,94	-106.409,06	-4,63%	-4,79%	9,33%
Total Renda Variável	616.200.124,53	28.074.751,97	24.381.735,34	614.193.982,12	-5.699.159,04	-0,92%		6,99%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Agosto / 2021)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	33.179.796,97	0,00	0,00	34.128.037,88	948.240,91	2,86%	2,86%	5,47%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	24.127.863,37	0,00	0,00	24.715.472,97	587.609,60	2,44%	2,44%	6,20%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR AÇÕES RESP LIMITADA...	0,00	6.000.000,00	0,00	6.139.432,76	139.432,76	2,32%	2,24%	6,36%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	18.766.494,91	0,00	0,00	19.012.295,00	245.800,09	1,31%	1,31%	5,88%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	6.717.267,73	0,00	0,00	6.783.587,98	66.320,25	0,99%	0,99%	6,00%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR R...	7.657.496,80	0,00	0,00	7.727.173,27	69.676,47	0,91%	0,91%	5,92%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	19.048.998,30	0,00	0,00	19.202.778,67	153.780,37	0,81%	0,81%	5,27%
Total Exterior	109.497.918,08	6.000.000,00	0,00	117.708.778,53	2.210.860,45	1,91%		5,76%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO & MERCADO ENGENHARIA FINANCEIRA.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

